

信息披露 Disclosure

东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金

[2010] 年度报告摘要

基金管理人:东吴基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年三月三十一日
§ 重要提示及目录

1.1 重要提示
本基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其中的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字确认,并由董事长签发。

本基金托管人:中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)根据本基金合同规定,于2011年3月30日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,对相关信息不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

本基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要自年度报告正文、投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2010年1月1日起至12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称 东吴嘉禾优势精选混合
基金代码 580001
交易代码 580001
基金运作方式 契约型开放式
基金合同生效日 2005年2月1日
基金管理人 东吴基金管理有限公司
基金托管人 中国工商银行股份有限公司
报告期基金份额总额 3,393,783,060.74份
基金合同存续期 不定期

2.2 基金产品说明

投资目标 分享中国经济成长,在中低风险水平下获得中长期较高收益。

在资产配置上,本基金根据宏观经济风险收益水平及本基金风险收益目标,将资产配置于成长性高、追求中长期较高收益。在股票投资上,本基金根据个股行业、风格三重比较分析,精选个股,并根据宏观经济周期、行业生命周期及基金经理的判断,适时调整股票投资的时空和仓位配置,以进行中长期持有,同时根据指数及个股运行的时

间段,适时调整股票投资的时长比例。

业绩比较基准 65%*深证成份指数+10%*上证180指数+40%*深证100指数+35%*中信标普全债指数。

风险收益特征 本基金定位中低风险水平,力求通过选股方法、投资策略等,谋求中长期较高收益。

2.3 基金管理人和基金托管人

基金管理人 东吴基金管理有限公司
基金托管人 中国工商银行股份有限公司

信息披露义务人 黄忠平
联系电话 021-50509888-8219
电子邮箱 huangzh@fund.com.cn
客户服务电话 021-50509666
传真 021-50509888-8211
010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告的管理人互联网网址 www.scfund.com.cn
基金年度报告备置地点 东吴基金管理有限公司

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要财务数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标 2010年 2009年 2008年

本期已实现收益 141,083,077.34 522,166,520.47 -2,058,264,264.53

本期利润 483,681,010.33 900,382,428.09 -2,237,598,056.78

加权平均基金份额本期利润 0.1374 -0.2611 -0.5012

本期基金份额净价增长率 17.88% 39.00% -48.85%

3.1.2 期末数据和指标 2010年末 2009年末 2008年末

期末可供分配基金份额利润 -0.3149 -0.3561 -0.4834

期末基金资产净值 3,099,353,459.66 2,806,194,493.80 2,375,067,69.39

期末基金份额净值 0.9130 0.7745 0.5572

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,即为本期实现收入扣除本期公允价值变动收益。

2.期末可供分配金额除以期末资产净值即为本期利润分配比例,即本基金当年分配次数乘以本期利润分配比例。

3.上述基金业利润指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,例如基金的认购、申购、赎回费用等,计入费用后实际收益水平将低于所列数据。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 份额净值增长率
①
份额净值增长率
标准差
②
业绩比较基准
收益率
③
业绩比较基准
收益率
标准差
④

过去三个月 8.96% 1.75% 3.99% 0.18% 4.97% 0.57%

过去六个月 36.29% 1.50% 15.47% 1.03% 20.82% 0.47%

过去一年 17.88% 1.45% -0.41% 1.05% 24.29% 0.40%

过去三年 -12.91% 1.61% -19.70% 1.52% 6.79% 0.09%

过去五年 296.08% 1.63% 185.66% 1.42% 110.42% 0.21%

自基金成立以来 266.53% 1.54% 181.04% 1.35% 85.49% 0.19%

注:比较基准=65%*深证成份指数+10%*上证180指数+40%*深证100指数+35%*中信标普全债指数。

3.2.2 基金合同生效以来基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

(2005年2月1日至2010年12月31日)

东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

注:东吴嘉禾基金于2005年2月1日成立。

2.比较基准=65%*深证成份指数+10%*上证180指数+40%*深证100指数+35%*中信标普全债指数。

3.2.3 过去五年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

注:东吴嘉禾基金于2005年2月1日成立。

2.比较基准=65%*深证成份指数+10%*上证180指数+40%*深证100指数+35%*中信标普全债指数。

3.2.4 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

注:东吴嘉禾基金于2005年2月1日成立。

2.比较基准=65%*深证成份指数+10%*上证180指数+40%*深证100指数+35%*中信标普全债指数。

3.2.5 过去五年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

注:东吴嘉禾基金于2005年2月1日成立。

2.比较基准=65%*深证成份指数+10%*上证180指数+40%*深证100指数+35%*中信标普全债指数。

3.2.6 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

注:东吴嘉禾基金于2005年2月1日成立。

2.比较基准=65%*深证成份指数+10%*上证180指数+40%*深证100指数+35%*中信标普全债指数。

3.2.7 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

注:东吴嘉禾基金于2005年2月1日成立。

2.比较基准=65%*深证成份指数+10%*上证180指数+40%*深证100指数+35%*中信标普全债指数。

3.2.8 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

注:东吴嘉禾基金于2005年2月1日成立。

2.比较基准=65%*深证成份指数+10%*上证180指数+40%*深证100指数+35%*中信标普全债指数。

3.2.9 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

注:东吴嘉禾基金于2005年2月1日成立。

2.比较基准=65%*深证成份指数+10%*上证180指数+40%*深证100指数+35%*中信标普全债指数。

3.2.10 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

注:东吴嘉禾基金于2005年2月1日成立。

2.比较基准=65%*深证成份指数+10%*上证180指数+40%*深证100指数+35%*中信标普全债指数。

3.2.11 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

注:东吴嘉禾基金于2005年2月1日成立。

2.比较基准=65%*深证成份指数+10%*上证180指数+40%*深证100指数+35%*中信标普全债指数。

3.2.12 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

注:东吴嘉禾基金于2005年2月1日成立。

2.比较基准=65%*深证成份指数+10%*上证180指数+40%*深证100指数+35%*中信标普全债指数。

3.2.13 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

注:东吴嘉禾基金于2005年2月1日成立。

2.比较基准=65%*深证成份指数+10%*上证180指数+40%*深证100指数+35%*中信标普全债指数。

3.2.14 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

注:东吴嘉禾基金于2005年2月1日成立。

2.比较基准=65%*深证成份指数+10%*上证180指数+40%*深证100指数+35%*中信标普全债指数。

3.2.15 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

注:东吴嘉禾基金于2005年2月1日成立。

2.比较基准=65%*深证成份指数+10%*上证180指数+40%*深证100指数+35%*中信标普全债指数。

3.2.16 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

注:东吴嘉禾基金于2005年2月1日成立。

2.比较基准=65%*深证成份指数+10%*上证180指数+40%*深证100指数+35%*中信标普全债指数。

3.2.17 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

注:东吴嘉禾基金于2005年2月1日成立。

2.比较基准=65%*深证成份指数+10%*上证180指数+40%*深证100指数+35%*中信标普全债指数。

3.2.18 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金